

**上证红利交易型开放式指数证券投资基金
上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告**

友邦华泰基金管理有限公司

公告日期：二〇〇七年一月十五日

一、重要声明与提示

《上证红利交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告》（以下简称“本上市交易公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则（2004年修订）》的规定编制，友邦华泰基金管理有限公司（即基金管理人）的董事会及董事保证本上市交易公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

招商银行股份有限公司（即基金托管人）保证本上市交易公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对上证红利交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在10月24日、10月25日、10月30日《上海证券报》、《证券时报》和《中国证券报》上并在友邦华泰基金管理有限公司网站（www.aig-huatai.com）、招商银行网站（www.cmbchina.com）上公告的《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

- 1、基金二级市场交易简称：红利ETF。
- 2、二级市场交易代码：510880。
- 3、基金申购、赎回简称：红利申赎。
- 4、申购、赎回代码：510881。
- 5、2007年1月11日基金份额总额：1,456,675,703份。
- 6、2007年1月11日基金份额净值：2.018元。
- 7、本次上市交易份额：1,456,675,703份。
- 8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 9、上市交易日期：2007年1月18日。
- 10、基金管理人：友邦华泰基金管理有限公司。
- 11、基金托管人：招商银行股份有限公司。
- 12、上市推荐人：华泰证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司。
- 13、申购赎回代办证券公司（简称“一级交易商”）：华泰证券有限责任公司、国泰君安证

券股份有限公司、国信证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、财通证券经纪有限责任公司、万联证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司。

三、基金的募集与上市交易

(一) 基金募集

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会 2006 年 9 月 26 日证监基金字[2006]196 号文。

2、基金运作方式：交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：自 2006 年 10 月 30 日至 2006 年 11 月 10 日进行发售，其中，网下现金发售的日期为 2006 年 10 月 30 日至 2006 年 11 月 10 日，网上现金发售和网下股票发售的日期为 2006 年 11 月 8 日至 2006 年 11 月 10 日。

5、发售价格：人民币 1.00 元。

6、发售期限：10 个工作日。

7、发售方式：投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。

8、发售协调人

主协调人：华泰证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司。

副主协调人：中信建投证券有限责任公司、国信证券有限责任公司、联合证券有限责任公司。

9、发售机构

(1) 直销机构

投资者可通过友邦华泰基金管理有限公司的直销网点办理基金的网下现金认购。

(2) 代销机构

本基金网下现金认购和网下股票认购的代理机构包括华泰证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、国信证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、申银万国证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、中信万通有限责任公司、中

原证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、金通证券股份有限公司、天和证券经纪有限公司、财通证券经纪有限责任公司、兴业证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、江南证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、国联证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、华西证券有限责任公司、信泰证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、南京证券有限责任公司和万联证券有限责任公司等 41 家证券公司。

本基金网上现金发售通过具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理，现有华泰证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、国信证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、广东证券股份有限公司、西南证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、大同证券经纪有限责任公司、民生证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、北京证券有限责任公司、长江证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、天同证券有限责任公司、渤海证券有限责任公司、大鹏证券有限责任公司、金通证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、国元证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国联证券有限责任公司、金信证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、东北证券有限责任公司、天和证券经纪有限公司、南京证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、泰阳证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、第一证券有限公司、国都证券有限责任公司、恒泰证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、华西证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、西北证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、宏源证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、金元证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、信泰证券有限责任公司、江南证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、财通证券经纪有限责任公司等 68 家证券公司。

（二）基金合同生效

截至 2006 年 11 月 10 日,基金募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资,本次募集金额总额为 2,222,985,094.00 元人民币(含募集股票以及募集期间利息 22,275 元)。募集资金已于 2006 年 11 月 16 日划入本基金在基金托管人招商银行股份有限公司开立的基金托管专户,募集股票已于 2006 年 11 月 15 日由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理过户。

本次募集有效认购户数为 29,193 户,按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算,募集基金份额总额为 2,222,985,094 份,已全部计入投资者账户,归投资者所有。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的有关规定,友邦华泰基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于 2006 年 11 月 17 日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。

(三) 基金份额折算

根据《基金合同》和《招募说明书》的有关规定,本基金管理人确定 2007 年 1 月 10 日为基金份额折算日。当日上证红利指数收盘值为 2074.803 点,基金资产净值为 3,022,309,942.98 元,折算前基金份额总额为 2,222,985,094 份,折算前基金份额净值为 1.360 元。

根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为 0.65527799,折算后基金份额总额为 1,456,675,703 份,折算后基金份额净值为 2.075 元。

本基金管理人已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于 2007 年 1 月 11 日进行变更登记。折算后的基金份额采取四舍五入的方法保留到整数位。投资者可以自 2007 年 1 月 12 日起在其上海证券账户指定的销售机构查询折算后其持有的基金份额。

本基金管理人和基金托管人已根据折算后的基金份额总额进行了相应的会计处理,并互相核对。

(四) 基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号:上海证券交易所《关于上证红利交易型开放式指数证券投资基金上市交易及申购赎回的通知》上证债字[2007]4 号。

2、上市交易日期:2007 年 1 月 18 日。

3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。

4、基金二级市场交易简称：红利 ETF。

5、二级市场交易代码：510880。

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

6、基金申购、赎回简称：红利申赎。

7、申购、赎回代码：510881。

投资者只能通过指定的代办证券公司（一级交易商）参与基金申购、赎回。目前，一级交易商包括华泰证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、财通证券经纪有限责任公司、万联证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司。

8、本次上市交易份额：1,456,675,703 份。

9、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至 2007 年 1 月 11 日，本基金份额持有人户数为 29,193 户，平均每户持有的基金份额为 49,898 份。

（二）持有人结构

截至 2007 年 1 月 11 日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的基金份额为 550,361,426 份，占基金总份额的 37.78%；个人投资者持有的基金份额为 906,314,277 份，占基金总份额的 62.22%。

（三）前十名基金份额持有人情况

截至日期：2007 年 1 月 11 日

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占基金总份额的比例 (%)
1	中国人寿保险（集团）公司	65,528,946	4.50
2	中国人寿保险股份有限公司	65,528,946	4.50
3	华泰证券—招行—华泰紫金 2 号集合资产管理计划	39,316,679	2.70

4	中国平安保险（集团）股份有限公司	32,764,145	2.25
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司	32,764,145	2.25
6	中国太平洋保险公司	32,764,145	2.25
7	长江证券有限责任公司	19,658,340	1.35
8	太平人寿保险有限公司－传统－普通保险产品－022L-CT001 沪	19,658,225	1.35
9	宝钢集团有限公司	19,658,225	1.35
10	万向财务有限公司	13,106,281	0.90

五、基金主要当事人情况

（一）基金管理人

1、基本情况

名称：友邦华泰基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 40 楼

法定代表人：齐亮

总经理：陈国杰

成立日期：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178 号

法人营业执照文号：企合国字第 001088 号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

2、股权结构

AIG Global Investment Corp. (AIGGIC) 49%、华泰证券有限责任公司 49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司 2%。

3、内部组织

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。

目前，公司下设 10 个部门，并在北京设立了分公司。

(1) 投资研究部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票投资、行业和上市公司研究，下设基金经理室、研究部和中央交易室，分别负责基金管理、投资研究和交易指令执行与监督。

(2) 渠道销售部：负责基金销售。

(3) 市场服务部：负责公司品牌、基金产品的市场推广及客户服务。

(4) 机构理财部：负责机构客户的业务拓展。

(5) 业务发展部：负责基金产品研发等新业务拓展。

(6) 基金事务部：负责基金会计核算与估值、开放式基金注册登记等业务。

(7) 信息技术部：负责公司信息系统的日常运行与开发。

(8) 法律监察部：负责内部法律事务咨询，处理外部法律事务，检查公司管理及基金运作符合国家法律法规规定的情况，并研究公司风险管理政策与方针，协调各部门处理公司层面风险事项。负责定期评估公司内部控制体系的完整性、有效性及合规性，检查公司内部控制制度的执行情况，并提出改进意见。

(9) 人力资源部：负责公司人力资源管理、薪酬制度、人员培训及人事档案等事务，负责后勤服务等综合事务管理。

(10) 公司财务部：负责公司财务事项。

4、人员情况

截至 2006 年 12 月，我公司共有员工 62 人，获得基金从业资格的有 47 人。所有人员在最近 3 年内均没有受到有关监管部门的处罚。

5、信息披露负责人：陈晖

电话：021-50479200

传真：021-50478668

6、基金管理业务情况

截至 2007 年 1 月 11 日，公司管理资产规模 39.80 亿元人民币，旗下共有友邦华泰盛世中国股票型基金、友邦华泰中短期债券基金和上证红利 ETF 等 3 只开放式基金。

7、本基金基金经理

张娅女士：美国俄亥俄州肯特州立大学金融工程硕士、MBA，具有多年海内外金融从业经验。曾在芝加哥期货交易所、Danzas-AEI 公司、SunGard Energy 和联合证券工作，2004 年初加入友邦华泰基金管理有限公司，从事投资研究和金融工程工作。

(二) 基金托管人情况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称招商银行）

设立日期：1987 年 4 月 8 日

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

注册资本：122.79 亿元

法定代表人：秦晓

行长：马蔚华

托管部门负责人：夏博辉

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】83 号

资产托管部信息披露负责人：姜然

电话：0755—83195226

传真：0755—83195201

2、基金托管部门

2002 年 11 月 6 日，招商银行股份有限公司经中国证券监督管理委员会和中国人民银行批准，取得证券投资基金托管人资格，是国内第一家取得基金托管人资格的上市银行。除基金托管资格外，招商银行现已取得受托投资管理托管业务资格，合格境外机构投资者托管人资格（QFII），全国社会保障基金托管资格和企业年金基金托管人资格和保险资金托管资格。

招商银行总行设立资产托管部负责证券投资基金托管业务，内设综合管理室、核算清算室、稽核监察室三个职能部门，并在上海设立了分部。招商银行资产托管部拥有安全可靠的财务核算计价、交易监督系统及高效快捷的先进的“网银通”电子化资金清算服务体系，现有员工 20 人。

3、托管业务情况

截至 2006 年 6 月 30 日，招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金（含招商安泰股票投资基金、招商平衡型证券投资基金和招商债券投资基金），招商现金增值证券投资基金、中信经典配置证券投资基金、长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金和友邦华泰中短期债券投资基金及其它托管资产，托管资产总规模已近 400 亿元人民币。

（三）上市推荐人

1、华泰证券有限责任公司

法定代表人：吴万善

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

联系人：李金龙、张小波

联系电话：（025）84579897

2、国泰君安证券股份有限公司

法定代表人：祝幼一

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

联系人：芮敏祺

联系电话：（021）62580818

（四）申购赎回代办证券公司（一级交易商）

1、华泰证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：（025）84457777-882、721

传真：（025）84579879

联系人：袁红彬、李金龙

客服电话：（025）84579897

公司网址：www.htsc.com.cn

2、国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：祝幼一

电话：（021）62580818

传真：（021）62583439

联系人：芮敏祺

客服电话：800-820-6888

公司网址：www.gtja.com

3、国信证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 21 楼

法定代表人：何如

电话：（0755）82133066

传真：（0755）82133302

联系人：林建闽

客服电话：800-810-8868

公司网址： www.guosen.com.cn

4、中国银河证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：朱利

电话：010-66568613、66568587

传真：010-66568536

联系人：郭京华

客服电话：010-68016655

公司网址：www.chinastock.com.cn

5、联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人：马国强

电话：（0755）82493561

传真：（0755）82492062

联系人：盛宗凌

客服电话：400-8888-555

公司网址：www.lhzq.com

6、光大证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦 15 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦 15 楼

法定代表人：王明权

电话：021-68816770

传真：021-68817271

联系人：张琦

客服电话：10108998

公司网址：www.ebscn.com

7、申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：谢平

电话：021-54033888

传真：021-64738844

联系人：王序微

客服电话：021-962505

公司网址：www.sw2000.com.cn

8、招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39-45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943511

传真：0755-82943237

联系人：黄健

客服电话：4008888111、0755-26951111

公司网址：www.newone.com.cn

9、广发证券股份有限公司

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 36、38、41、42 楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888

传真：020-87557985

联系人：肖中梅

客服电话：020-87555888

公司网址：www.gf.com.cn

10、财通证券经纪有限责任公司

注册地址：杭州市解放路 111 号

办公地址：杭州市解放路 111 号

法定代表人：陈海晓

电话：(0571) 87828146

传真：(0571) 87828033

联系人：叶毓蔚

客服电话：(0571) 87828018

公司网址：www.goodyou.com.cn

11、万联证券有限责任公司

注册地址：广州市东山区东风东路 836 号东峻广场 34-34 层

办公地址：广州市东山区东风东路 836 号东峻广场 34-34 层

法定代表人：李舫金

电话：(020) 87691530

传真：(020) 87691530

联系人：邱亚娟

客服电话：(020) 87691530

公司网址：www.wlzq.com.cn

12、中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区湖贝路 1030 号海龙王大厦

办公地址：北京市新源南路 6 号京城大厦 3 楼

法定代表人：王东明

电话：010-84864818-63266

传真：010- 84865560

联系人：陈忠

客服电话：010-84588266

公司网址：www.ecitic.com

13、长江证券有限责任公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号

法定代表人：明云成

联系人：毕艇

电话：027-65799560

传真：027-85481532

客服电话：4008888999

公司网址：www.cz318.com.cn

14、中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：黎晓宏

电话：(010) 65183888

传真：(010) 65182261

联系人：魏明

客服电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

15、上海证券有限责任公司

注册地址：上海市九江路 111 号

办公地址：上海市临平北路 19 号

法定代表人：蒋元真

电话：021- 65076608-557

传真：021 -65213164

联系人：刘永

客服电话：021-962518

公司网址：www.962518.com

16、中原证券股份有限公司

注册地址：许昌市南关大街 38 号

办公地址：郑州市经三路 15 号广汇国贸大厦 10 楼

法定代表人：张建刚

电话：0371—65585610

传真：0371-65585665

联系人：梁锦宝

客服电话：0371-967218

公司网址：www.ccnew.com

17、南京证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

电话：025-83367888-4101

传真：025-83364032

联系人：胥春阳

客服电话：025-83364032

公司网站：www.njzq.com.cn

18、山西证券有限责任公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：吴晋安

电话：(0351) 8686766、8686708

传真：(0351) 8686709

联系人：张治国

客服电话：(0351) 8686868

公司网址：www.i618.com.cn

19、中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市市南区东海西路 28 号

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

电话：0532-85023905

传真：0532-85023905

联系人：李锦

客服电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

（五）验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

经办注册会计师：汪棣、陈宇

电话：021-61238888

传真：021-61238800

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用从基金认购费用中支付，不由基金资产承担。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

截至 2007 年 1 月 11 日，本基金的资产负债表如下：（单位：元）

项 目	金 额	项 目	金 额
资产：		负债：	
银行存款	15,839,112.01	应付证券清算款	-
清算备付金	33,700,000.00	应付赎回款	-
交易保证金	-	应付赎回费	-
应收证券清算款	-	应付管理人报酬	417,312.40
应收股利	-	应付托管费	83,462.48
应收利息	155,168.04	应付佣金	2,619,600.90
应收申购款	-	应付利息	-
其他应收款	-	应付收益	-
股票投资市值	2,892,970,124.76	未交税金	-
其中：股票投资成本	2,246,480,940.66	其他应付款	-
债券投资市值	-	卖出回购证券款	-
其中：债券投资成本	-	预提费用	65,560.32
权证投资	-	其他负债	-
其中：权证投资成本	-	负债合计	3,185,936.10
买入返售证券	-	持有人权益：	
待摊费用	-	实收基金	2,222,985,094.00

其他资产	-	未实现利得	646,489,184.10
		未分配收益	70,004,190.61
		持有人权益合计	2,939,478,468.71
资产合计	2,942,664,404.81	负债及持有人权益合计	2,942,664,404.81

八、基金投资组合

截至 2007 年 1 月 11 日，本基金的投资组合情况如下：

（一）基金资产组合情况

序号	资产组合	金额(元)	占总资产比例(%)
1	股票投资	2,892,970,124.76	98.31
2	债券投资	-	-
3	权证投资	-	-
4	银行存款和清算备付金合计	49,539,112.01	1.68
5	应收证券清算款	-	-
6	其他资产	155,168.04	0.01
	合计	2,942,664,404.81	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	48,816,488.92	1.66
B	采掘业	400,455,470.51	13.62
C	制造业	1,646,086,968.48	56.00
C0	其中：食品、饮料	44,987,329.44	1.53
C1	纺织、服装、皮毛	126,064,733.33	4.29
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	99,483,484.82	3.38
C5	电子	15,918,750.43	0.54
C6	金属、非金属	1,011,805,433.62	34.42
C7	机械、设备、仪表	315,190,566.84	10.72
C8	医药、生物制品	-	-

C99	其他	32,636,670.00	1.11
D	电力、煤气及水的生产和供应业	278,747,574.95	9.48
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	87,469,683.24	2.98
G	信息技术业	16,945,303.95	0.58
H	批发和零售贸易	41,825,876.66	1.42
I	金融、保险业	120,270,091.76	4.09
J	房地产业	172,035,053.31	5.85
K	社会服务业	80,317,612.98	2.73
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合 计	2,892,970,124.76	98.42

(三) 按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占资产净值比例(%)
1	600019	宝钢股份	51,662,456	484,593,837.28	16.49
2	600028	中国石化	35,244,052	364,775,938.20	12.41
3	600005	武钢股份	30,830,693	228,763,742.06	7.78
4	600104	上海汽车	19,326,305	178,188,532.10	6.06
5	600015	华夏银行	16,520,617	120,270,091.76	4.09
6	600642	申能股份	14,207,889	120,198,740.94	4.09
7	600177	雅戈尔	10,510,011	105,100,110.00	3.58
8	600001	邯郸钢铁	16,470,180	83,174,409.00	2.83
9	600383	金地集团	4,584,482	82,474,831.18	2.81
10	600688	S 上石化	9,578,048	65,801,189.76	2.24

(四) 期末按券种分类的债券投资组合

截至 2007 年 1 月 11 日, 本基金未持有债券。

(五) 投资组合报告附注

1、本基金前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2、本基金前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成如下：

序号	其他资产	金额(元)
1	应收利息	155,168.04

4、权证投资情况

截至 2007 年 1 月 11 日，本基金未持有权证；自基金合同生效日至 2007 年 1 月 11 日，本基金未投资任何权证。

5、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2007 年 1 月 11 日，本基金未持有可转换债券。

6、本报告期末按市值占基金净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

截至 2007 年 1 月 11 日，本基金未持有资产支持证券。

九、重大事件揭示

2007 年 1 月 10 日，本基金进行了基金份额折算，具体内容详见第三条第（三）款“（三）基金份额折算”。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、上海证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易之后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。

（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回价格的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支

付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为华泰证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司。上市推荐人华泰证券有限责任公司是本基金管理人的股东，国泰君安证券股份有限公司与本基金管理人、基金托管人之间不存在任何关联关系。

上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：

- 1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则（2004 年修订）》规定的相关条件；
- 2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十三、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回的开放日及时间

1、申购、赎回的开始时间

自 2007 年 1 月 18 日起，本基金开始办理申购、赎回。

2、开放日及开放时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所的交易日，开放时间为上午 9:30-11:30 和下午 1:00-3:00。在此时间之外不办理基金份额的申购、赎回。

若上海证券交易所变更交易时间或出现其他特殊情况，基金管理人可对开放日、开放时间内进行相应的调整并公告。

（二）申购和赎回场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金的申购和赎回。

目前，基金申购、赎回代办证券公司（一级交易商）包括华泰证券有限责任公司、国泰

君安证券股份有限公司、国信证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、财通证券经纪有限责任公司、万联证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、山西证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司。

（三）申购和赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

本基金最小申购、赎回单位为 50 万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改前至少 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（四）申购和赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。
- 2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
- 3、申购、赎回申请提交后不得撤销。
- 4、申购、赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定。
- 5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟须于新规则开始实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（五）申购和赎回的程序

1、申购和赎回申请的提出

投资者须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的开放时间提出申购、赎回的申请。投资者申购本基金时，须根据申购、赎回清单备足相应数量的股票和现金。投资者提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金。

2、申购和赎回申请的确认与通知

基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。投资者可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点查询确认情况。

3、申购和赎回的清算交收与登记

投资者 T 日申购、赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算，在 T+1 日办理现金替代等的交收以及现金差额的

清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（六）申购、赎回的对价、费用及价格

1、申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。

2、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

3、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购、赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购、赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。

4、投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

（七）申购、赎回清单的内容与格式

1、申购、赎回清单的内容

T 日申购、赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T 日预估现金部分、T-1 日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购、赎回清单将公告最小申购、赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

（1）现金替代分为 3 种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

(2) 可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资人无法在申购时买入的证券。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额 = 替代证券数量 × 该证券最新价格 × (1 + 现金替代溢价比例)

其中，“最新价格”的确定原则为：

- (i) 该证券正常交易时，采用最新成交价；
- (ii) 该证券正常交易中出现涨停时，采用涨停价格；
- (iii) 该证券停牌且当日有成交时，采用最新成交价；
- (iv) 该证券停牌且当日无成交时，采用前一交易日收盘价（考虑当日的除权除息等因素）。

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购、赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资人收取欠缺的差额。

③替代金额的处理程序

T 日，基金管理人在申购、赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。

在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。

T+2 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T+2 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。

特例情况：若自 T 日起，上海证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价

计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。

若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股以及由于股权分置改革等发生的权益变动，则进行相应调整。

T+2 日后第 1 个工作日（若在特例情况下，则为 T 日起第 21 个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

④替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资人使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

$$\text{现金替代比例 (\%)} = \frac{\sum_{i=1}^n \text{第 } i \text{ 只替代证券的数量} \times \text{该证券最新价格}}{\text{申购基金份额} \times \text{最新基金份额参考净值 (IOPV)}} \times 100\%$$

(3) 必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购、赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购、赎回清单中该证券的数量乘以其 T 日预计开盘价。

4、预估现金部分相关内容

预估现金部分是指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。

T 日申购、赎回清单中公告 T 日预估现金部分。其计算公式为：

T 日预估现金部分 = T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - (申购、赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额 + 申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与 T 日预计开盘价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 T 日预计开盘价相乘之和)

其中，T 日预计开盘价主要根据上海证券交易所提供的标的指数成份证券的预计开盘价确定。另外，若 T 日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T 日现金差额在 T+1 日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

$$T \text{ 日现金差额} = T \text{ 日最小申购、赎回单位的基金资产净值} - (\text{申购、赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额} + \text{申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与 } T \text{ 日收盘价相乘之和} + \text{申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 } T \text{ 日收盘价相乘之和})$$

T 日投资者申购、赎回基金份额时，需按 T+1 日公告的 T 日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

6、申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期	2007-1-8
基金名称	上证红利交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	友邦华泰基金管理有限公司
一级市场基金代码	510881

2007 年 1 月 5 日信息内容

现金差额（单位：元）	¥ -4,625.19
最小申购、赎回单位资产净值（单位：元）	¥ 622,700.81
基金份额净值（单位：元）	¥ 1.245

2007 年 1 月 8 日信息内容

预估现金部分（单位：元）	¥ -552.19
现金替代比例上限	20%
是否需要公布 IOPV	是
最小申购、赎回单位（单位：份）	500,000

申购、赎回的允许情况	允许申购、允许赎回
------------	-----------

成份股信息内容

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	固定替代金额
600001	邯郸钢铁	3800	禁止		
600005	武钢股份	7100	禁止		
600008	首创股份	2000	禁止		
600011	华能国际	1500	禁止		
600015	华夏银行	3800	禁止		
600019	宝钢股份	11800	禁止		
600022	济南钢铁	1000	禁止		
600028	中国石化	8100	禁止		
600033	福建高速	1300	禁止		
600059	古越龙山	300	禁止		
600064	南京高科	500	禁止		
600066	宇通客车	600	禁止		
600087	南京水运	800	禁止		
600096	云天化	500	禁止		
600098	广州控股	1900	禁止		
600104	上海汽车	4400	禁止		
600126	杭钢股份	600	禁止		
600151	航天机电	700	禁止		
600153	建发股份	700	禁止		
600177	雅戈尔	2400	禁止		
600189	吉林森工	400	禁止		
600210	紫江企业	2300	禁止		
600231	凌钢股份	700	禁止		
600236	桂冠电力	900	禁止		
600282	南钢股份	1100	禁止		
600300	维维股份	600	禁止		

600302	标准股份	400	禁止		
600303	曙光股份	300	禁止		
600307	酒钢宏兴	800	禁止		
600317	营口港	300	禁止		
600323	南海发展	400	禁止		
600327	大厦股份	400	禁止		
600383	金地集团	1000	禁止		
600418	江淮汽车	1600	禁止		
600508	上海能源	600	禁止		
600510	黑牡丹	500	禁止		
600533	栖霞建设	300	禁止		
600548	深高速	600	禁止		
600563	法拉电子	300	禁止		
600569	安阳钢铁	2300	禁止		
600581	八一钢铁	700	禁止		
600598	北大荒	1100	禁止		
600621	上海金陵	900	禁止		
600626	申达股份	600	禁止		
600642	申能股份	3300	禁止		
600675	中华企业	1100	禁止		
600688	上海石化	2200	禁止		
600808	马钢股份	2100	禁止		
600886	国投电力	1100	禁止		
600971	恒源煤电	200	禁止		

(八) 暂停申购、赎回的情形

在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的申购、赎回申请：

- 1、不可抗力导致基金无法接受申购、赎回；
- 2、上海证券交易所决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3、基金管理人开市前未公布申购、赎回清单；

4、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日报中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额兑付。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并予以公告。

（九）集合申购与其他服务

在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资人集合其持有的组合证券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。

在条件允许时，基金管理人也可采取其他合理的申购方式，并于新的申购方式开始执行前的至少三个工作日予以公告。

基金管理人指定的代理机构可依据基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

十四、备查文件

以下备查文件存放在基金管理人、基金托管人的办公场所、营业场所，投资者可免费查阅。

- （一）中国证监会核准上证红利交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- （二）《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三）《上证红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- （四）《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- （五）《证券登记及服务协议》及附加协议
- （六）法律意见书
- （七）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （八）基金托管人业务资格批件、营业执照

友邦华泰基金管理有限公司

二〇〇七年一月十五日

附件：基金合同摘要

基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利、义务

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自取得依据基金合同发行的基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

1、基金份额持有人的权利

- 1) 分享基金财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- 3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

2、基金份额持有人的义务

- 1) 遵守基金合同；
- 2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- 3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法利益的活动；
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 6) 法律法规及基金合同规定的其它义务。

（二）基金管理人的权利和义务

1、基金管理人的权利

- 1) 自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；
- 2) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

- 3) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式, 获得基金管理费, 收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用;
- 4) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额;
- 5) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人, 如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的, 应及时呈报中国证监会和中国银监会, 以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益;
- 6) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查;
- 7) 自行承担基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构, 办理基金注册登记业务, 并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查;
- 8) 在基金合同约定的范围内, 拒绝或暂停受理申购和赎回的申请;
- 9) 在法律法规允许的前提下, 为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资;
- 10) 依据法律法规和基金合同的规定, 制订基金收益的分配方案;
- 11) 按照法律法规, 代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利;
- 12) 在基金托管人职责终止时, 提名新的基金托管人;
- 13) 依据法律法规和基金合同的规定, 召集基金份额持有人大会;
- 14) 以基金管理人名义, 代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
- 15) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率;
- 16) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

2、基金管理人的义务

- 1) 依法募集基金, 办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
- 2) 办理基金备案手续;
- 3) 自基金合同生效之日起, 以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
- 4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策, 以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
- 5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 保证所管理的基金财产和基金管理人的资产相互独立, 对所管理的不同基金分别管理、分别记账, 进行证券投

资；

- 6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 7) 依法接受基金托管人进行的监督；
- 8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按照有关规定计算并公告基金份额净值，确定基金份额申购、赎回的清单；
- 9) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 10) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前，应予以保密，不得向他人泄露；
- 11) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- 12) 按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资者申购之基金份额或赎回之对价；
- 13) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会，或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 14) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 15) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- 16) 编制中期和年度基金报告；
- 17) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到公开披露的基金信息，并在支付合理成本后得到有关资料的复印件；
- 18) 组织并参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 19) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 22) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；
- 23) 公平对待所管理的不同基金，防止在不同基金间进行有损本基金份额持有人的利益及资

源分配；

24) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

25) 执行生效的基金份额持有人大会决定；

26) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

（三）基金托管人的权利和义务

1、基金托管人的权利

1) 依据法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；

3) 监督本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；

4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

7) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

2、基金托管人的义务

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；

2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

3) 建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

4) 除依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定外，不以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

7) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

8) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息

公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

- 9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；
- 10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 11) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 12) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；
- 13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- 15) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- 16) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- 17) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 18) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- 19) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；
- 20) 因违反基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- 21) 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动；
- 22) 执行生效的基金份额持有人大会决定；
- 23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- 24) 法律、法规、本基金合同和依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

(二) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上(含 10%，下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止基金合同；
- 2) 转换基金运作方式；
- 3) 变更基金类别；
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- 5) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- 6) 更换基金管理人、基金托管人；
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 8) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的事项；
- 9) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
- 10) 本基金与其他基金的合并；
- 11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3) 经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；
- 4) 经中国证监会允许，基金管理人、交易所和登记结算机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；
- 5) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 6) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 7) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 8) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（三）召集人和召集方式

1、除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，

基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

3、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

（四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- 2) 会议拟审议的主要事项；
- 3) 会议形式；
- 4) 议事程序；
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- 6) 授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；
- 7) 表决方式；
- 8) 会务常设联系人姓名、电话；
- 9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 10) 召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系

方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

（五）基金份额持有人出席会议的方式

1、会议方式

- 1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。
- 2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席基金份额持有人大会。
- 3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。
- 4) 会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、基金管理人的更换或基金托管人的更换、终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

2、召开基金份额持有人大会的条件

1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

- ① 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效的凭证所对应的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；
- ② 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间(至少应在 30 日后)和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

- ① 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；
- ② 召集人在基金托管人或/和基金管理人（分别或共同地称为“监督人”）以及公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；
- ③ 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

④ 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记结算机构记录相符。

如果开会条件达不到上述要求，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在30日后)，且确定有权参与表决的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(六) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前40天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前30天公告。

3) 对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案)，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

① 关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

② 程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。

2、议事程序

1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

基金份额持有人大会由基金管理人召集的，大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表；基金份额持有人大会由基金托管人召集的，大会主持人为基金托管人授权出席会议的代表；基金份额持有人大会由基金份额持有人召集的，大会主持人为召集基金份额持有人大会的基金份额持有人自行选举的代表。如果大会主持人未能按前述规定确定，则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额 50%以上多数（不含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码（或住所地址）、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名（或单位名称）等事项。

2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前至少 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 日统计全部有效表决，在公证机关及监督人的监督下形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3、基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

（七）决议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 50%以上多数（不含 50%）通过方为有效，除下列 2) 所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

- 3、基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。
- 4、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
- 5、基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（八）计票

1、现场开会

- 1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。
- 2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。
- 3) 如大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。
- 4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代理共同担任监票人进行计票；
- 5) 计票过程应由公证机关予以公证。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监督员进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

（九）基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

- 1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案、并自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于基

金合同变更、更换基金管理人、基金托管人等事项的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行。

2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在至少一种指定媒体公告。

(十) 法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

基金收益分配原则、执行方式

(一) 收益分配原则

- 1、基金收益分配采用现金方式；
- 2、每一基金份额享有同等分配权；
- 3、基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配；
- 4、基金收益分配比例的确定原则：根据上证红利指数成份股当季分红实际情况，尽量做到每季均匀分红，并使收益分配后基金份额净值尽可能贴近标的指数的千分之一。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。
- 5、全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的 90%，自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配，基金收益分配每年至多 4 次；
- 6、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

(二) 基金收益分配数额的确定原则

- 1、在收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率、标的指数同期累计报酬率。

基金累计报酬率为收益评价日基金份额净值与基金份额折算日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%；标的指数同期累计报酬率为收益评价日标的指数收盘价与基金份额折算日标的指数收盘价之比减去 1 乘以 100%。

基金管理人将以此计算截至收益评价日基金超过标的指数的收益率=基金累计报酬率-标的指数同期累计报酬率

当超额收益率超过 1%时，基金管理人有权进行收益分配。

- 2、计算截至基金收益评价日本基金的净收益，并根据前述原则确定收益分配比例。
- 3、每基金份额的应分配收益为上述基金净收益乘以收益分配比例，计算基金收益分配金额，

然后除以基金收益评价日发售在外的基金份额总额，保留小数点后 3 位，第 4 位舍去。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（六）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定、经基金托管人复核后，报中国证监会备案，并在备案后在指定媒体公告。

与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金财产划拨支付的银行费用；
- 4、基金上市费及年费；
- 5、基金收益分配中发生的费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 8、基金份额持有人大会费用；
- 9、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 10、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起二个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于当日从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起二个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于当日从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第（一）款第 3 至第 10 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。基金收取认购费的，可以从认购费中列支。基金标的指数使用费由基金管理人承担，国家另有规定可以将指数使用费列入基金费用的，从其规定。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

本基金的主要投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

（二）投资范围以及投资比例

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。

（三）禁止行为

依照《基金法》，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券，但标的指数成份股不受此限；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，但标的指数成份股不受此限，法律法规或监管部门另有规定的除外；
- 7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如果法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，本基金不受上述限制。

（四）投资限制

依照《运作办法》，基金管理人运用基金财产进行证券投资，不得有下列情形：

- 1、基金财产参与股票发行申购，单只基金所申报的金额超过基金总资产，单只基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 2、违反基金合同关于投资范围和投资策略等约定；
- 3、中国证监会规定禁止的其他情形。

如果法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，本基金不受上述限制。

基金资产净值的计算方法和公告方式

（一）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（二）基金净值公告方式

本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值

登载在指定报刊和网站上。

基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

(一) 基金合同的变更

1、变更基金合同应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意并变更后公布，并报中国证监会备案：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、基金合同经基金份额持有人大会决议同意变更的，基金合同的变更自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金合同不需经基金份额持有人大会决议同意而进行变更的，基金合同变更后应及时公告并报中国证监会备案，基金合同的变更内容自公告之日起生效。

(二) 基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内没有新任基金管理人承接其原有权利义务；
- 3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内没有新任基金托管人承接其原有权利义务；
- 4、法律法规或中国证监会规定的其他情况。

(三) 基金财产的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

1) 自基金合同终止事由之日起三十个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会

计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

3、清算程序

- 1) 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 基金财产清算组作出清算报告；
- 6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 8) 将基金清算结果报中国证监会备案；
- 9) 公布基金清算公告；
- 10) 对基金财产进行分配。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算组优先从基金财产中支付。

5、基金财产按下列顺序清偿：

- 1) 支付清算费用；
- 2) 交纳所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1) —3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

6、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果由基金财产清算小组经中国证监会备案后 3 个工作日内公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存十五年以上。

争议解决方式

(一) 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二) 本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决, 则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会, 根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的, 对仲裁各方当事人均具有约束力。

(三) 除争议所涉内容之外, 本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册, 存放在基金管理人和基金托管人住所, 供投资人查阅, 基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。